

工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证  
券投资基金  
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 20 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	工银科技创新3年封闭混合
基金主代码	007353
基金运作方式	契约型；本基金基金合同生效后，设定一个三年的封闭期，封闭运作期届满后，本基金转为开放式基金。
基金合同生效日	2019年5月6日
报告期末基金份额总额	989,482,399.73份
投资目标	本基金主要投资受益于科技创新主题的A股和港股通标的中优质的上市公司股票，采用积极主动的投资策略，在合理的风险限度内，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断国内及香港证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例。本基金所界定的科技创新企业主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。
业绩比较基准	70%×中国战略新兴产业成份指数收益率+5%×恒生指数收益率+25%×中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差

	异带来的特有风险。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年10月1日-2020年12月31日）
1. 本期已实现收益	63,867,638.42
2. 本期利润	302,987,838.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3062
4. 期末基金资产净值	2,128,328,221.07
5. 期末基金份额净值	2.1510

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

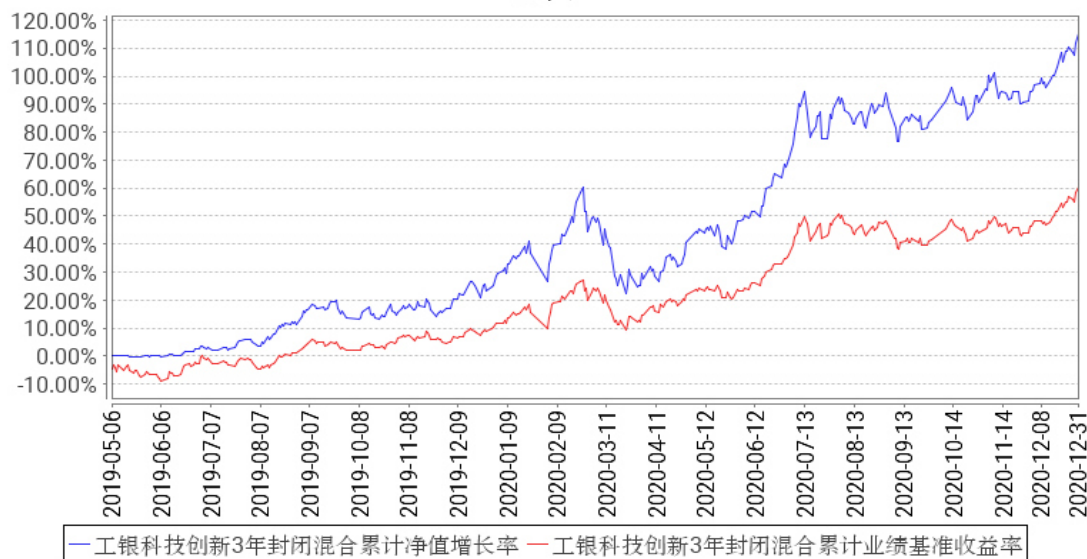
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	16.60%	1.30%	13.23%	1.00%	3.37%	0.30%
过去六个月	27.71%	1.56%	18.81%	1.18%	8.90%	0.38%
过去一年	72.11%	1.92%	45.36%	1.29%	26.75%	0.63%
自基金合同 生效起至今	115.10%	1.59%	60.18%	1.16%	54.92%	0.43%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银科技创新3年封闭混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2019年5月6日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于封闭期内投资范围及投资限制的规定：股票占基金资产的比例为60% - 100%（投资于港股通投资标的股票的比例占基金股票资产的比例为0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内的证券比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，股票投资部分可以以战略配售的方式进行投资。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张继圣	本基金的基金经理	2019年5月6日	-	23年	先后在友邦证券投资信托股份有限公司担任分析师，在统一证券投资信托股份有限公司担任分析师、专业副总；2018年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，2018年12月19日至今，担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理；2019年5月6日至今，担任工银瑞信科技创新3年封闭运作混合型证券投资基金基金经理；2020年4

					月7日至今,担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理;2020年5月20日至今,担任工银瑞信科技创新6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理;2020年6月18日至今,担任工银瑞信高质量成长混合型证券投资基金基金经理。
袁芳	本基金的基金经理	2019年5月6日	-	13年	曾在嘉实基金担任股票交易员;2011年加入工银瑞信,现任研究部基金经理,2015年12月30日至今,担任工银瑞信文体产业股票型证券投资基金基金经理;2018年2月13日至2020年12月31日,担任工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年5月6日至今,担任工银瑞信科技创新3年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。2020年4月23日至今,担任工银瑞信圆兴混合型证券投资基金基金经理。2020年6月18日至今,担任工银瑞信高质量成长混合型证券投资基金基金经理。
胡志利	本基金的基金经理	2020年12月30日	-	8年	2012年加入工银瑞信,现任权益投资部基金经理,2015年8月18日至2017年12月26日,担任工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理;2016年10月10日至2018年2月23日,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年1月25日至今,担任工银瑞信优质精选混合型证券投资基金基金经理;2017年4月14日至2018年6月12日,担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年4月27日至2018年8月28日,担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年2月27日至2019年8月14日,担任工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金基金经理。2019年11月7日至今,担任工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金基金经理;2019年11月7日至今,担任工银瑞信现代服务业灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2020年12月30日至今,担任工银瑞信科技创新3年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期;离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有2次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度市场行业轮动比较激烈，10月、11月市场行情演绎了对于货币和信贷政策收紧的担忧，表现为传统周期类低估值资产的反弹；12月由于央行的定调相对市场预期更“鸽”，市场又反向

演绎成长股的行情。本基金在操作上，延续三季度以来的策略，即在周期和成长方面保持相对平衡的行业配置，整体在四季度没有太多的策略性操作。

管理人认为一季度是2021年相对较好的时间窗口，一方面，外部环境较好，欧美疫情随着疫苗的接种进入改善通道，美联储货币和财政政策支持实体经济的恢复；另一方面，国内的宏观政策相对温和，且一季度有较多的新发基金，流动性相对充分。优质成长股依然是主力配置的方向，板块上相对看好军工、有色，新能源板块感觉风险或将大于机会。2021年全年来看，相对谨慎，成长股估值相对较高，而且2021年的宏观流动性环境的边际友好程度或将弱于2020年。但是上下半年可能有节奏分化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为16.60%，业绩比较基准收益率为13.23%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,857,097,798.00	86.95
	其中：股票	1,857,097,798.00	86.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,923,758.50	0.14
	其中：债券	2,923,758.50	0.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	275,217,102.70	12.89
8	其他资产	511,505.37	0.02
9	合计	2,135,750,164.57	100.00

注：1、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为445,631,488.00元，占期末资产净值比例为20.94%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,062,635,634.40	49.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,176,375.11	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	39,134,733.88	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,308,536.45	6.40
J	金融业	5,665,560.00	0.27
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	67,667,536.95	3.18
M	科学研究和技术服务业	24,238,305.20	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,146,598.00	0.76
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	49,468,973.77	2.32
S	综合	-	-
	合计	1,411,466,310.00	66.32

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务 Communication Services	92,942,344.00	4.37
非必需消费品 Consumer Discretionary	-	-
必需消费品 Consumer Staples	-	-
能源 Energy	-	-
金融 Financials	66,854,130.00	3.14



保健 Health Care	22,971,060.00	1.08
工业 Industrials	29,456,460.00	1.38
信息技术 Information Technology	179,628,894.00	8.44
材料 Materials	53,778,600.00	2.53
房地产 Real Estate	-	-
公用事业 Utilities	-	-
合计	445,631,488.00	20.94

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	02382	舜宇光学科技	824,800	117,806,184.00	5.54
2	00700	腾讯控股	195,800	92,942,344.00	4.37
3	603129	春风动力	485,800	84,621,502.00	3.98
4	300750	宁德时代	210,300	73,838,433.00	3.47
5	601919	中远海控	3,203,500	39,114,735.00	1.84
5	01919	中远海控	3,762,000	29,456,460.00	1.38
6	600399	ST 抚钢	4,499,950	67,049,255.00	3.15
7	00388	香港交易所	186,900	66,854,130.00	3.14
8	01772	赣锋锂业	690,000	53,778,600.00	2.53
8	002460	赣锋锂业	73,500	7,438,200.00	0.35
9	002241	歌尔股份	1,521,300	56,774,916.00	2.67
10	601012	隆基股份	568,500	52,415,700.00	2.46

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,923,758.50	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,923,758.50	0.14

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113038	隆20转债	10,190	1,796,395.10	0.08
2	113611	福20转债	7,830	1,127,363.40	0.05

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

#### 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	334,096.61
2	应收证券清算款	148,428.23
3	应收股利	-
4	应收利息	28,980.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511,505.37

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	989,482,399.73
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	989,482,399.73

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；  
2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定，工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金参与存托凭证投资，并修订基金合同和托管协议等法律文件，包括增加投资存托凭证的风险揭示、明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，自 2020 年 10 月 14 日起正式生效。详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

2、自 2020 年 12 月 30 日起，胡志利担任工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 1 月 20 日